

華南永昌證券投資信託股份有限公司 函

地 址：10574台北市民生東路四段54號3樓之
1

承辦人：翁維駿

電 話：02-27196688 分機3308

傳 真：02-25148452

電子信箱：simon.weng@hnfunds.com.tw

110

台北市信義區信義路五段8號12樓

受文者：英屬百慕達商安達人壽保險（股
）台灣分公司

發文日期：中華民國110年1月22日

發文字號：華永信字第1100000028號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：

主旨：謹通知修訂「華南永昌低波動多重資產基金」（以下簡稱
本基金）公開說明書之投資策略相關內容，請查照。

說明：

- 一、考量基金操作及投資範圍篩選之彈性，申請修訂本基金公
開說明書之投資策略。
- 二、業經金管會109年11月20日金管證投字第1090375690號函
同意辦理。
- 三、檢附公開說明書相關內容之修訂對照表及金管會同意辦理
函件。

正本：英屬百慕達商安達人壽保險（股）台灣分公司

副本：

授權單位主管決行

總經理 黃時彥

華南水產經營發展信託
股份有限公司
總經理 黃時彥

裝

訂

線

檔 號：
保存年限：

金融監督管理委員會 函

地址：22041新北市板橋區縣民大道2段7號1
8樓

承辦人：陳先生
電話：02-27747348
傳真：02-87734154

受文者：華南永昌證券投資信託股份有限公司（代表人呂金火先生）

發文日期：中華民國109年11月20日
發文字號：金管證投字第1090375690號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：
附件：

主旨：所請貴公司經理之「華南永昌低波動多重資產證券投資信託基金」調整投資策略修正公開說明書一案，同意照辦，並請依說明事項辦理。

說明：

- 一、依據本會證券期貨局案陳貴公司109年11月13日華永信字第1090000378號函辦理。
- 二、請依證券投資信託事業募集證券投資信託基金公開說明書應記載事項準則第25條及本會93年11月11日金管證四字第0930005499號規定，於本會備查函送達之日起3日內將修正後公開說明書傳送至公開資訊觀測站。

正本：華南永昌證券投資信託股份有限公司（代表人呂金火先生）
副本：中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會（代表人張錫先生）

電2020/11/20
交17:48章

行銷企劃部

109/11/20



華南永昌證券投資信託股份有限公司公告

中華民國 109 年 11 月 日

華永信字第 1090000 號

主旨：本公司經理之「華南永昌低波動多重資產證券投資信託基金」(以下簡稱本基金)修訂公開說明書之投資策略乙案，業經金融監督管理委員會(以下簡稱金管會)核備，特此公告。

說明：

- 一、本案業經金管會 109 年 11 月 20 日金管證投字第 1090375690 號函核准。
- 二、考量基金操作彈性及為擴大基金投資參考範圍以增加投資機會，本基金修訂公開說明書之股票、債券投資策略。本次修訂事項不涉及基金投資基本方針及產品定位之變更，自公告日之翌日起生效適用。
- 三、本次公開說明書修訂對照表如下，修訂後之公開說明書可於公開資訊觀測站 (<http://mops.twse.com.tw>)及本公司網站(<http://www.hnfunds.com.tw>)下載。

華南永昌低波動多重資產基金公開說明書修訂條文對照表

條項	修訂後	修訂前
十、投資策略及特色之重點摘述 (一)投資策略	1.原則上，本基金投資組合以股票、債券、基金受益憑證(含ETF)為建構方向，投資策略主要透過低波動股票、政府公債及選擇權之資產組合配置，以達到跟隨指數上漲、較佳的下跌保護力、降低資產組合波動度及風險等投資目標。在控制投資組合波動目標下，將每日檢視並伺機調整股票及固定收益之部位配置比重。 2.股票投資策略：本基金股票配置比重0%~70%，股票篩選參考標普500低波動指數(S&P 500 Low Volatility Index)成分股，由投資團隊檢視個股基本面，決定投資標的及權重。 3.債券投資策略：本基金債券比重最高不超過70%，債券策略主要投資於成熟國家政府公債，藉由公債之高安全性、低波動等特性與優勢，以達到降低市場下跌時投資風險之效益。 <u>另也會依市場狀況，檢視投資等級債的投資機會。</u> 4.基金受益憑證(含ETF)投資策略：基	1.原則上，本基金投資組合以股票、債券、基金受益憑證(含ETF)為建構方向，投資策略主要透過低波動股票、政府公債及選擇權之資產組合配置，以達到跟隨指數上漲、較佳的下跌保護力、降低資產組合波動度及風險等投資目標。在控制投資組合波動目標下，將每日檢視並伺機調整股票及固定收益之部位配置比重。 2.股票投資策略：本基金股票配置比重0%~70%，股票篩選參考BNP Paribas美國低波動指數(BNP Paribas Equity Low Vol US Index)成分股，由投資團隊檢視個股基本面，決定投資標的及權重。 3.債券投資策略：本基金債券比重最高不超過70%，債券策略主要投資於成熟國家政府公債，藉由公債之高安全性、低波動等特性與優勢，以達到降低市場下跌時投資風險之效益。 4.基金受益憑證(含ETF)投資策略：基於流動性因素、分散標的風險、降低

條項	修訂後	修訂前
	<p>於流動性因素、分散標的風險、降低交易成本及靈活執行或調整投資組合需求等考量，本基金將彈性佈局於基金受益憑證，單一基金受益憑證不超過本基金淨資產價值20%。</p> <p>5.為控制資產組合波動度，本基金將搭配投資於衍生自股價指數或指數股票型基金(ETF)之選擇權，透過買進選擇權賣權策略，提供投資組合下檔保護支撐，強化投資組合抵禦下跌風險的能力。</p>	<p>交易成本及靈活執行或調整投資組合需求等考量，本基金將彈性佈局於基金受益憑證，單一基金受益憑證不超過本基金淨資產價值20%。</p> <p>5.為控制資產組合波動度，本基金將搭配投資於衍生自股價指數或指數股票型基金(ETF)之選擇權，透過買進選擇權賣權策略，提供投資組合下檔保護支撐，強化投資組合抵禦下跌風險的能力。</p>